

گزارش صورت وضعیت پرتفوی ماهانه



برای دوره یک ماهه منتهی به بهمن ماه

۱۴۰۳

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت پرتفوی

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ بهمن ماه ۱۴۰۳

۱- سرمایه گذاری ها

۱-۱-سرمایه‌گذاری در سهام

۱۴۰۳/۱۱/۳۰					تغییرات طی دوره				۱۴۰۳/۱۰/۳۰			شرکت
درصد به کل دارایی‌ها	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	قیمت بازار هر سهم	تعداد	فروش طی دوره		خرید طی دوره		خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد	
					مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده	تعداد				
درصد	ریال	ریال	ریال		ریال		ریال		ریال	ریال		
۱۴.۳۸	۶۳۸,۰۴۳,۴۹۴,۷۸۰	۲۸۹,۰۶۰,۹۸۱,۹۲۲	۲۶,۵۱۰	۲۴,۰۸۲,۶۷۳	۶۳۰,۸۴۸,۸۲۹,۹۵۵	(۲۲,۵۷۲,۸۷۳)	۴۵,۷۶۴,۶۳۸,۸۴۸	۱,۷۲۳,۴۹۸	۱,۱۶۹,۷۶۸,۱۹۸,۶۵۱	۵۰۳,۴۱۶,۰۲۲,۷۹۰	۴۴,۹۳۲,۰۴۸	داروسازی سینا
۳۹.۳۷	۱,۷۴۶,۲۱۵,۰۸۸,۱۰۳	۱,۷۰۷,۸۵۰,۵۴۹,۳۴۷	۱,۸۱۷	۹۶۱,۶۲۷,۶۴۶	۱۱۲,۴۲۰,۵۵۱,۱۶۶	(۵۷,۹۶۷,۰۰۰)	۱۲۵,۶۹۳,۰۲۳,۳۸۸	۶۵,۹۳۴,۰۰۰	۱,۹۰۰,۴۴۳,۱۵۵,۷۳۳	۱,۶۸۴,۸۶۵,۲۰۳,۹۴۷	۹۵۳,۶۶۰,۶۴۶	سرمایه گذاری خوارزمی
۵۳.۷۵	۲,۳۸۴,۲۵۸,۵۸۲,۸۸۳	۱,۹۹۶,۹۱۱,۵۳۱,۲۶۹		۹۸۵,۷۱۰,۳۱۹	۷۴۳,۲۶۹,۳۸۱,۱۲۱	(۸۰,۵۳۹,۸۷۳)	۱۷۱,۴۵۷,۶۶۲,۲۳۶	۶۷,۶۵۷,۴۹۸	۳,۰۷۰,۲۱۱,۳۵۴,۳۸۳	۲,۱۸۸,۲۸۱,۲۲۶,۷۳۷	۹۹۸,۵۹۲,۶۹۴	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم
 صورت وضعیت پرتفوی
 برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ بهمن ماه ۱۴۰۳

۱- سرمایه‌گذاری ها
 ۱-۲- سرمایه‌گذاری در واحدهای صندوق های سرمایه‌گذاری

تغییرات طی دوره												
فروش/ ابطال طی دوره						خرید/صدور طی دوره						
صندوق	تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	تعداد	بهای تمام شده	مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	تعداد	بهای تمام شده	درصد به کل دارایی‌ها
	ریال	ریال	ریال	ریال	ریال	ریال	ریال	ریال	ریال	ریال	ریال	درصد
صندوق س توسعه فولاد- ثابت	۱۲,۶۵۳,۳۵۰	۱۷۷,۸۶۴,۵۲۲,۳۴۸	۱۸۳,۱۶۰,۸۵۲,۲۰۰	۴۱۹,۱۷۰	۶,۰۸۱,۲۰۰,۸۶۰	(۱۰,۱۴۱,۴۱۶)	۱۴۸,۹۳۸,۱۵۵,۰۴۴	۲,۹۳۱,۱۰۴	۱۴,۸۰۷	۳۹,۹۳۵,۲۱۱,۳۰۳	۴۳,۳۹۲,۷۱۹,۲۶۷	۰.۹۸
صندوق س. دارا الگوریتم-د	۲۴,۸۷۱,۶۲۵	۳۷۳,۱۶۹,۴۷۳,۶۵۱	۳۷۴,۰۳۳,۱۴۷,۰۴۴	۲۱۲,۱۴۳,۶۵۸	۳,۲۴۲,۲۸۲,۲۱۷,۷۴۱	(۲۳۷,۰۱۴,۸۲۵)	۳,۶۲۶,۸۸۰,۹۷۵,۵۵۱	۴۵۸	۱۵,۳۹۶	۷,۰۳۷,۷۳۷	۷,۰۵۱,۱۵۶	۰.۰۰
صندوق س.مانا الگوریتم-سهام	۱,۲۵۰,۲۴۶	۱۲۱,۴۱۰,۱۵۴,۴۶۰	۱۳۲,۷۵۰,۸۹۷,۷۳۶	۱۰۴,۴۵۲	۱۰,۸۵۴,۰۵۲,۸۳۱	(۲۳,۴۰۲)	۲,۴۷۹,۴۴۵,۱۹۱	۱,۳۳۱,۲۹۶	۱۰۰,۳۰۰	۱۲۹,۹۸۶,۷۹۵,۴۴۷	۱۳۳,۵۰۳,۶۱۸,۲۹۲	۳.۰۱
صندوق ارمغان فیروزه آسیا- ثابت	۲۱۵,۰۰۰	۱۱,۵۱۵,۰۶۰,۷۷۶	۱۱,۶۱۳,۲۳۵,۰۰۰	۶,۲۶۸,۳۸۰	۳۴۳,۵۸۰,۶۴۰,۹۶۰	(۲,۱۵۵,۳۱۰)	۱۱۷,۳۶۵,۳۲۲,۷۸۶	۴,۳۲۸,۰۷۰	۵۵,۳۶۸	۲۳۸,۲۳۲,۱۸۸,۶۷۰	۲۳۹,۶۳۶,۵۷۹,۷۶۰	۵.۴۰
صندوق س افرا نماد پایدار- ثابت	.	.	.	۷۷۷,۰۰۰	۲۴,۹۰۸,۲۹۶,۴۲۸	(۷۷۷,۰۰۰)	۲۴,۹۴۶,۳۴۵,۶۸۶	.	.	.	.	۰.۰۰
جمع	۳۸,۹۹۰,۲۲۱	۶۸۳,۹۵۹,۲۱۱,۲۳۵	۷۰۱,۵۵۸,۱۲۱,۹۸۰	۲۱۹,۷۱۲,۶۶۰	۳,۶۲۷,۷۰۶,۴۰۸,۸۲۰	(۲۵۰,۱۱۱,۹۵۳)	۳,۹۲۰,۶۱۰,۲۴۴,۲۵۸	۸,۵۹۰,۹۲۸		۴۰۸,۱۶۱,۲۳۳,۱۵۷	۴۱۶,۵۳۹,۹۶۸,۴۷۶	۹.۳۹

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت پرتفوی

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ بهمن ماه ۱۴۰۳

۱-۲- سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی‌الحساب

اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت												
نام اوراق	دارای مجوز از سازمان	پذیرفته شده در بورس یا فرابورس	تاریخ انتشار اوراق	تاریخ سررسید	۱۴۰۳/۰۶/۳۱		۱۴۰۳/۰۷/۳۰					
صکوک اجاره خوارزم ۴۴۱۱-۶ماهه ۲۰٪	بله	بله	۱۴۰۰/۱۱/۱۸	۱۴۰۴/۱۱/۱۸	۲۰٪	۲۰٪						
مراجعه ت.صنعتی مشفق ۱۴۰۵۰۹۲۱	بله	بله	۱۴۰۱/۰۹/۲۱	۱۴۰۵/۰۹/۲۱	۱۸٪	۱۸٪						
تغییرات طی دوره												
نام اوراق	تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	خرید طی دوره		فروش طی دوره		تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	تعداد	قیمت بازار هر ورقه
				تعداد	بهای تمام شده	تعداد	مبلغ فروش					
			ریال		ریال		ریال		ریال			ریال
صکوک اجاره خوارزم ۴۴۱۱-۶ماهه ۲۰٪	۵۰۱,۶۳۸	۵۰۱,۵۷۹,۵۹۰,۲۱۲	۵۴۱,۱۹۴,۹۱۶,۰۹۳	۷,۵۰۰	۷,۴۲۵,۸۵۳,۸۷۵	۰	۰	۵۰۹,۱۳۸	۵۰۹,۰۰۵,۴۴۴,۰۸۷	۵۰۷,۰۱۳,۴۷۳,۵۲۲	۱۱,۴۳	ریال
مراجعه ت.صنعتی مشفق ۱۴۰۵۰۹۲۱	۴۴۰,۰۰۰	۴۴۰,۰۱۴,۶۰۰,۰۰۰	۴۴۸,۱۷۱,۱۲۲,۵۱۵	۰	۰	۰	۰	۴۴۰,۰۰۰	۴۴۰,۰۱۴,۶۰۰,۰۰۰	۴۵۴,۷۲۲,۰۰۷,۵۱۶	۱۰,۲۵	ریال
جمع	۹۴۱,۶۳۸	۹۴۱,۵۹۴,۱۹۰,۲۱۲	۹۸۹,۳۶۶,۰۳۸,۶۰۸	۷,۵۰۰	۷,۴۲۵,۸۵۳,۸۷۵	۰	۰	۹۴۹,۱۳۸	۹۴۹,۰۲۰,۰۴۴,۰۸۷	۹۶۱,۷۳۵,۴۸۱,۰۳۸	۲۱,۶۸	

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت پرتفوی

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ بهمن ماه ۱۴۰۳

۳-۱- سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی

۱۴۰۳/۱۱/۳۰		تغییرات طی دوره		۱۴۰۳/۱۰/۳۰		مشخصات حساب بانکی			
درصد به کل دارایی‌ها	مبلغ	کاهش	افزایش	مبلغ	نرخ سود علی الحساب	تاریخ افتتاح حساب	نوع سپرده	شماره حساب	سپرده های بانکی
درصد	ریال	ریال	ریال	ریال	درصد				
۰.۰۲	۸۲۴,۶۸۱,۹۲۰	۵۰۵,۰۴۱,۷۵۵,۵۶۰	۵۰۵,۰۵۱,۱۲۵,۴۷۲	۸۱۵,۳۱۲,۰۰۸	۵	۱۴۰۲/۰۵/۱۴	سپرده کوتاه مدت	۰۲۱۸۲۰۳۴۹۱۰۰۷	بانک صادرات میدان فرهنگ
۰.۰۰	۷,۲۷۱,۳۱۹	۲,۴۳۲,۵۳۲,۹۹۸,۸۸۵	۲,۴۳۲,۴۵۸,۱۰۸,۰۵۹	۸۲,۱۶۲,۱۴۵	۵	۱۴۰۲/۰۵/۱۴	سپرده کوتاه مدت	۰۲۱۸۲۰۳۵۰۰۰۰۰	بانک صادرات میدان فرهنگ
۰.۰۰	۱۱۳,۷۹۳,۷۸۸	۴۶,۱۷۳,۸۲۵,۰۵۹	۴۶,۱۲۸,۲۱۱,۰۵۱	۱۵۹,۴۰۷,۷۹۶	۵	۱۴۰۲/۰۵/۱۴	سپرده کوتاه مدت	۰۲۱۸۲۰۳۶۶۷۰۰۸	بانک صادرات میدان فرهنگ
۰.۰۰	۶۱,۴۳۴,۸۷۲	۹۳,۸۲۷,۶۱۷,۸۳۳	۹۳,۷۸۹,۰۵۳,۰۶۰	۹۹,۹۹۹,۶۴۵	۵	۱۴۰۲/۰۵/۱۴	سپرده کوتاه مدت	۰۲۱۸۲۰۳۶۷۲۰۰۱	بانک صادرات میدان فرهنگ
۰.۰۲	۶۹۹,۵۱۳,۳۰۲	۶,۶۳۹,۶۶۰,۹۲۴	۶,۶۶۵,۷۴۴,۸۰۸	۶۷۳,۴۲۹,۴۱۸	۵	۱۴۰۲/۰۵/۱۴	سپرده کوتاه مدت	۰۲۱۸۲۰۳۶۹۵۰۰۵	بانک صادرات میدان فرهنگ
۰.۰۰	۹۶,۵۱۵,۵۰۵	۱۱,۶۱۰,۳۶۹,۷۱۰	۱۱,۶۷۱,۷۲۲,۶۷۰	۳۵,۱۶۲,۵۴۵	۵	۱۴۰۳/۰۵/۲۴	سپرده کوتاه مدت	۰۲۱۹۰۷۹۳۵۱۰۰۹	بانک صادرات میدان فرهنگ
۰.۰۴	۱,۸۰۳,۲۱۰,۷۰۶	۳,۰۹۵,۸۲۶,۲۲۷,۹۷۱	۳,۰۹۵,۷۶۳,۹۶۵,۱۲۰	۱,۸۶۵,۴۷۳,۵۵۷					جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ بهمن ماه ۱۴۰۳

۲- درآمد حاصل از سرمایه گذاری ها

شرح	یادداشت	مبلغ	درصد از کل درآمدها	درصد از کل دارایی ها
درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم سهام	۱-۲	۷۷۷,۷۸۳,۶۳۰,۷۲۵	۶۹.۱۶	۱۷.۵۴
درآمد حاصل از سرمایه گذاری در واحدهای صندوق های سرمایه گذاری	۲-۲	۹۷,۵۴۷,۷۷۰,۳۴۰	۸.۶۷	۲.۲۰
درآمد حاصل از سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت	۳-۲	۷۴,۱۸۷,۷۲۹,۰۸۸	۶.۶۰	۱.۶۷
درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده	۴-۲	۳۷,۰۳۸,۱۷۵	۰.۰۰	۰.۰۰
سایر درآمدها	۵-۲	۱۷۵,۰۶۶,۰۹۴,۸۳۹	۱۵.۵۷	۳.۹۵
جمع		۱,۱۲۴,۶۲۲,۲۶۳,۱۶۷	۱۰۰	۲۵.۴

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم
 صورت وضعیت درآمدها
 برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ بهمن ماه ۱۴۰۳

۱-۲-۱ درآمد سود سهام

اطلاعات مجمع			طی بهمن ماه ۱۴۰۳			از ابتدای سال مالی تا پایان بهمن ماه سال ۱۴۰۳		
نام سهام	تاریخ تشکیل مجمع	تعداد سهام متعلقه در زمان مجمع	سود متعلق به هر سهم	جمع درآمد سود سهام	هزینه تنزیل	خالص درآمد سود سهام	جمع درآمد سود سهام	هزینه تنزیل
خالص درآمد سود سهام	ریال	ریال	ریال	ریال	ریال	ریال	ریال	ریال
سرمایه گذاری خوارزمی	۱۴۰۳/۰۷/۲۶	۸۵۳,۴۲۹,۰۲۴	۳۰۰	-	-	۰	۲۵۶,۰۲۸,۷۰۷,۲۰۰	۰
جمع				۰	۰	۰	۲۵۶,۰۲۸,۷۰۷,۲۰۰	۰

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ بهمن ماه ۱۴۰۳

۲-۱ درآمد ناشی از تغییر قیمت اوراق بهادار

از ابتدای سال مالی تا پایان بهمن ماه سال ۱۴۰۳				طی بهمن ماه ۱۴۰۳				شرح
سود و زیان ناشی از تغییر قیمت	ارزش دفتری	خالص ارزش فروش	تعداد	سود و زیان ناشی از تغییر قیمت	ارزش دفتری	خالص ارزش فروش	تعداد	
ریال	ریال	ریال		ریال	ریال	ریال		
۵۰,۶۷۸,۵۷۵,۹۷۸	(۱,۶۹۵,۵۳۶,۵۱۲,۱۲۴)	۱,۷۴۶,۲۱۵,۰۸۸,۱۰۲	۹۶۱,۶۲۷,۶۴۶	(۱۷۷,۹۸۰,۶۰۰,۴۸۲)	(۱,۹۲۴,۱۹۵,۶۸۸,۵۸۴)	۱,۷۴۶,۲۱۵,۰۸۸,۱۰۲	۹۶۱,۶۲۷,۶۴۶	سرمایه گذاری خوارزمی
۲۲۲,۳۵۶,۳۶۱,۸۰۰	(۴۱۵,۶۸۷,۱۳۲,۹۷۹)	۶۳۸,۰۴۳,۴۹۴,۷۷۹	۲۴,۰۸۲,۶۷۳	(۱۹۴,۸۲۶,۴۹۶,۷۷۷)	(۸۳۲,۸۶۹,۹۹۱,۵۵۶)	۶۳۸,۰۴۳,۴۹۴,۷۷۹	۲۴,۰۸۲,۶۷۳	شرکت لابراتوارهای سینا دارو
۱,۴۰۴,۳۹۱,۰۹۰	(۲۳۸,۲۳۲,۱۸۸,۶۷۰)	۲۳۹,۶۳۶,۵۷۹,۷۶۰	۴,۳۲۸,۰۷۰	۱,۳۰۶,۲۲۶,۸۶۶	(۲۳۸,۳۳۰,۳۵۲,۸۹۴)	۲۳۹,۶۳۶,۵۷۹,۷۶۰	۴,۳۲۸,۰۷۰	صندوق ارمغان فیروزه آسیا-ثابت
۲,۵۲۲,۸۲۴,۲۱۶	(۱۳۰,۹۸۰,۷۹۴,۰۷۶)	۱۳۳,۵۰۳,۶۱۸,۲۹۲	۱,۳۳۱,۲۹۶	(۷,۸۰۵,۴۸۲,۲۶۵)	(۱۴۱,۳۰۹,۱۰۰,۵۵۷)	۱۳۳,۵۰۳,۶۱۸,۲۹۲	۱,۳۳۱,۲۹۶	صندوق س.مانا الگوریتم-سهام
۱۳,۴۱۹	(۷,۰۳۷,۷۳۷)	۷,۰۵۱,۱۵۶	۴۵۸	(۸۶۳,۶۵۹,۹۷۳)	(۸۷۰,۷۱۱,۱۲۹)	۷,۰۵۱,۱۵۶	۴۵۸	صندوق س. دارا الگوریتم-د
۳,۰۸۹,۳۲۰,۹۳۱	(۴۰,۳۰۳,۳۹۸,۳۳۶)	۴۳,۳۹۲,۷۱۹,۲۶۷	۲,۹۳۱,۱۰۴	(۱,۵۵۱,۸۷۶,۸۶۵)	(۴۴,۹۴۴,۵۹۶,۱۳۲)	۴۳,۳۹۲,۷۱۹,۲۶۷	۲,۹۳۱,۱۰۴	صندوق س توسعه فولاد- ثابت
.	(۴۳۹,۹۴۹,۴۰۰,۰۰۰)	۴۳۹,۹۴۹,۴۰۰,۰۰۰	۴۴۰,۰۰۰	.	(۴۳۹,۹۴۹,۴۰۰,۰۰۰)	۴۳۹,۹۴۹,۴۰۰,۰۰۰	۴۴۰,۰۰۰	مراجعه ت.صنعتی مشفق ۱۴۰۵۰۹۲۱
(۲,۰۴۹,۳۰۰)	(۵۰۳,۹۹۰,۷۰۳,۹۳۸)	۵۰۳,۹۸۸,۶۵۴,۶۳۸	۵۰۹,۱۳۸	(۱,۷۰۷,۷۵۰)	(۵۰۳,۹۹۰,۳۶۲,۳۸۸)	۵۰۳,۹۸۸,۶۵۴,۶۳۸	۵۰۹,۱۳۸	صکوک اجاره خوارزم ۴۴۱۱-۶ماهه ۲۰٪
۲۸۰,۰۴۹,۴۳۸,۱۳۴	(۳,۴۶۴,۶۸۷,۱۶۷,۸۶۰)	۳,۷۴۴,۷۳۶,۶۰۵,۹۹۴	۹۹۵,۲۵۰,۳۸۵	(۳۸۱,۷۲۳,۵۹۷,۲۴۶)	(۴,۱۲۶,۴۶۰,۲۰۳,۲۴۰)	۳,۷۴۴,۷۳۶,۶۰۵,۹۹۴	۹۹۵,۲۵۰,۳۸۵	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ بهمن ماه ۱۴۰۳

۳-۱-۲ سود(زیان) حاصل از فروش اوراق بهادار

از ابتدای سال مالی تا پایان بهمن ماه سال ۱۴۰۳				طی بهمن ماه ۱۴۰۳				شرح
سود و زیان ناشی از فروش	ارزش دفتری	خالص ارزش فروش	تعداد	سود و زیان ناشی از فروش	ارزش دفتری	خالص ارزش فروش	تعداد	
ریال	ریال	ریال		ریال	ریال	ریال		
(۶,۹۵۲,۱۱۱,۴۱۶)	(۵۷۴,۰۳۱,۶۱۴,۸۵۵)	۵۶۷,۰۷۹,۵۰۳,۴۳۹	۳۳۰,۹۴۵,۰۰۰	۱۰,۴۸۰,۰۶۰,۶۳۰	(۱۰۱,۹۴۰,۴۹۰,۵۳۶)	۱۱۲,۴۲۰,۵۵۱,۱۶۶	۵۷,۹۶۷,۰۰۰	سرمایه گذاری خوارزمی
۲۵۵,۶۷۲,۰۹۷,۱۶۳	(۴۰۰,۸۳۳,۸۷۳,۸۱۵)	۶۵۶,۵۰۵,۹۷۰,۹۷۸	۲۳,۶۵۷,۸۷۳	۲۴۸,۱۸۵,۹۷۰,۴۶۹	(۳۸۲,۶۶۲,۸۵۹,۴۸۶)	۶۳۰,۸۴۸,۸۲۹,۹۵۵	۲۲,۵۷۲,۸۷۳	شرکت لابراتوارهای سینا دارو
۵,۸۸۸,۱۴۱,۳۸۱	(۲,۰۳۲,۹۷۷,۳۱۵,۱۰۲)	۲,۰۳۸,۸۶۵,۴۵۶,۴۸۳	۳۹,۷۲۶,۱۵۰	۵۰۱,۸۰۹,۷۲۰	(۱۱۶,۸۶۳,۵۱۳,۰۶۶)	۱۱۷,۳۶۵,۳۲۲,۷۸۶	۲,۱۵۵,۳۱۰	صندوق ارمغان فیروزه آسیا-ثابت
۶,۱۶۹,۹۳۶,۵۴۸	(۱۶۹,۰۴۶,۴۴۹,۷۹۱)	۱۷۵,۲۱۶,۳۸۶,۳۳۹	۱,۳۷۷,۰۱۶	۱۸۳,۴۰۵,۶۰۴	(۲,۲۹۶,۰۳۹,۵۸۷)	۲,۴۷۹,۴۴۵,۱۹۱	۲۳,۴۰۲	صندوق س.مانا الگوریتم-سهام
۱,۳۳۳,۴۲۴,۳۲۱	(۳۵۶,۸۰۴,۴۵۱,۲۸۳)	۳۵۸,۱۳۷,۸۷۵,۶۰۴	۱۱,۳۴۹,۰۰۰	۳۸,۰۴۹,۲۵۸	(۲۴,۹۰۸,۲۹۶,۴۲۸)	۲۴,۹۴۶,۳۴۵,۶۸۶	۷۷۷,۰۰۰	صندوق س افرا نماد پایدار-ثابت
۴۵,۹۸۱,۸۵۴,۷۲۶	(۹,۳۱۴,۸۹۱,۴۵۲,۷۰۷)	۹,۳۶۰,۸۷۳,۳۰۷,۴۳۳	۶۴۲,۴۷۹,۱۰۹	۱۱,۴۹۴,۳۷۶,۲۶۹	(۲,۷۱۵,۴۳۴,۹۹۹,۲۸۲)	۲,۷۲۶,۹۲۹,۳۷۵,۵۵۱	۱۷۸,۰۱۴,۸۲۵	صندوق س. دارا الگوریتم-د
۲۲,۱۷۵,۸۸۵,۷۱۲	(۱,۱۸۸,۷۳۰,۵۱۷,۵۲۹)	۱,۲۱۰,۹۰۶,۴۰۳,۲۴۱	۸۷,۷۸۷,۴۶۶	۴,۶۴۰,۶۸۲,۲۰۶	(۱۴۴,۶۹۷,۴۷۲,۸۳۸)	۱۴۸,۹۳۸,۱۵۵,۰۴۴	۱۰,۱۴۱,۴۱۶	صندوق س توسعه فولاد- ثابت
۶,۴۳۰,۳۸۳,۳۳۳	(۱۵۰,۰۷۲,۸۴۸,۳۸۱)	۱۵۶,۵۰۳,۲۳۱,۷۱۴	۱۳,۸۱۵,۰۰۰	.	.	.	.	صندوق س.درآمدثابت شمیم تابان-د
۲,۵۵۱,۵۹۴,۶۶۳	(۲۴۹,۲۸۶,۷۳۲,۴۹۵)	۲۵۱,۸۳۸,۳۲۷,۱۵۸	۱۵,۵۰۰,۰۰۰	.	.	.	.	صندوق س. ارزش پاداش-د
۳۳۹,۲۵۱,۲۰۶,۴۳۱	(۱۴,۴۳۶,۶۷۵,۲۵۵,۹۵۸)	۱۴,۷۷۵,۹۲۶,۴۶۲,۳۸۹	۱,۱۶۶,۶۳۶,۶۱۴	۲۷۵,۵۲۴,۳۵۴,۱۵۶	(۳,۴۸۸,۴۰۳,۶۷۱,۲۲۳)	۳,۷۶۳,۹۲۸,۰۲۵,۳۷۹	۲۷۱,۶۵۱,۸۲۶	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ بهمن ماه ۱۴۰۳

۲-۱-درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم سهام:

از ابتدای سال مالی تا پایان بهمن ماه سال ۱۴۰۳					طی بهمن ماه ۱۴۰۳					
جمع		درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود سهام	جمع		درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود سهام	سهام
درصد از کل	مبلغ				درصد از کل	مبلغ				
درآمدها	ریال				درآمدها	ریال	ریال	ریال	ریال	
۲۶.۶۵	۲۹۹,۷۵۵,۱۷۱,۷۶۲	(۶,۹۵۲,۱۱۱,۴۱۶)	۵۰,۶۷۸,۵۷۵,۹۷۸	۲۵۶,۰۲۸,۷۰۷,۲۰۰	۲۷۴.۳۶	(۱۶۷,۵۰۰,۵۳۹,۸۵۲)	۱۰,۴۸۰,۰۶۰,۶۳۰	(۱۷۷,۹۸۰,۶۰۰,۴۸۲)	۰	سرمایه گذاری خوارزمی
۴۲.۵۱	۴۷۸,۰۲۸,۴۵۸,۹۶۳	۲۵۵,۶۷۲,۰۹۷,۱۶۳	۲۲۲,۳۵۶,۳۶۱,۸۰۰	۰	(۸۷.۴۰)	۵۳,۳۵۹,۴۷۳,۶۹۲	۲۴۸,۱۸۵,۹۷۰,۴۶۹	(۱۹۴,۸۲۶,۴۹۶,۷۷۷)	۰	شرکت لابراتوارهای سینا دارو
۶۹	۷۷۷,۷۸۳,۶۳۰,۷۲۵	۲۴۸,۷۱۹,۹۸۵,۷۴۷	۲۷۳,۰۳۴,۹۳۷,۷۷۸	۲۵۶,۰۲۸,۷۰۷,۲۰۰	۱۸۷	(۱۱۴,۱۴۱,۰۶۶,۱۶۰)	۲۵۸,۶۶۶,۰۳۱,۰۹۹	(۳۷۲,۸۰۷,۰۹۷,۲۵۹)	۰	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ بهمن ماه ۱۴۰۳

۲-۲- درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری در واحدهای صندوق

از ابتدای سال مالی تا پایان بهمن ماه سال ۱۴۰۳					طی بهمن ماه ۱۴۰۳				
صندوق	درآمد سود صندوق	درآمد تغییر ارزش	درآمد فروش	مبلغ	جمع	درصد از کل درآمدها	درآمد سود صندوق	درآمد تغییر ارزش	درآمد فروش
جمع	درصد از کل درآمدها	مبلغ	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود صندوق	جمع	درصد از کل درآمدها	مبلغ	درآمد فروش
صندوق ارمغان فیروزه آسیا-ثابت	۰	۱,۳۰۶,۲۲۶,۸۶۶	۵۰۱,۸۰۹,۷۲۰	۱,۸۰۸,۰۳۶,۵۸۶	۰.۱۶	۰	۰.۱۶	۱,۸۰۸,۰۳۶,۵۸۶	۵۰۱,۸۰۹,۷۲۰
صندوق س.مانا الگوریتم-سهام	۰	(۷,۸۰۵,۴۸۲,۲۶۵)	۱۸۳,۴۰۵,۶۰۴	-۷,۶۲۲,۰۷۶,۶۶۱	-۰.۶۸	۰	-۰.۶۸	-۷,۶۲۲,۰۷۶,۶۶۱	۱۸۳,۴۰۵,۶۰۴
صندوق س. دارا الگوریتم-د	۰	(۸۶۳,۶۵۹,۹۷۳)	۱۱,۴۹۴,۳۷۶,۲۶۹	۱۰,۶۳۰,۷۱۶,۲۹۶	۰.۹۵	۰	۰.۹۵	۱۰,۶۳۰,۷۱۶,۲۹۶	۱۱,۴۹۴,۳۷۶,۲۶۹
صندوق س. توسعه فولاد- ثابت	۰	(۱,۵۵۱,۸۷۶,۸۶۵)	۴,۶۴۰,۶۸۲,۲۰۶	۳,۰۸۸,۸۰۵,۳۴۱	۰.۳۷	۰	۰.۳۷	۳,۰۸۸,۸۰۵,۳۴۱	۴,۶۴۰,۶۸۲,۲۰۶
صندوق س. افرا نماد پایدار-ثابت	۰	۰	۳۸,۰۴۹,۲۵۸	۳۸,۰۴۹,۲۵۸	۰.۰۰	۰	۰.۰۰	۳۸,۰۴۹,۲۵۸	۳۸,۰۴۹,۲۵۸
صندوق س. ارزش پاداش-د	۰	۰	۰	۰	۰.۰۰	۰	۰.۰۰	۰	۰
صندوق س.درآمدثابت شمیم تابان-د	۰	۰	۰	۰	۰.۰۰	۰	۰.۰۰	۰	۰
جمع	۰	(۸,۹۱۴,۷۹۲,۲۳۷)	۱۶,۸۵۸,۳۲۳,۰۵۷.۰۰	۷,۹۴۳,۵۳۰,۸۲۰.۰۰	۰.۷۱	۰	۰.۷۱	۷,۹۴۳,۵۳۰,۸۲۰.۰۰	۱۶,۸۵۸,۳۲۳,۰۵۷.۰۰
جمع	۰	۹۷,۵۴۷,۷۷۰,۳۴۰.۰۰	۹۰,۵۳۱,۲۲۰,۶۸۴.۰۰	۷,۰۱۶,۵۴۹,۶۵۶.۰۰	۰.۰۰	۰	۰.۰۰	۷,۰۱۶,۵۴۹,۶۵۶.۰۰	۹۷,۵۴۷,۷۷۰,۳۴۰.۰۰

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ بهمن ماه ۱۴۰۳

۲-۳- درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت:

از ابتدای سال مالی تا پایان بهمن ماه سال ۱۴۰۳				طی بهمن ماه ۱۴۰۳				عنوان
جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود اوراق	جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود اوراق	
۳۲,۴۳۶,۳۷۷,۴۰۵	۰	۰	۳۲,۴۳۶,۳۷۷,۴۰۵	۶,۵۵۰,۸۸۵,۰۰۱	۰	۰	۶,۵۵۰,۸۸۵,۰۰۱	مراجعه ت. صنعتی مشفق ۱۴۰۵۰۹۲۱
۴۱,۷۵۱,۳۵۱,۶۸۳	۰	(۲,۰۴۹,۳۰۰)	۴۱,۷۵۳,۴۰۰,۹۸۳	۸,۳۸۶,۴۳۵,۶۸۰	۰	(۱,۷۰۷,۷۵۰)	۸,۳۸۸,۱۴۳,۴۳۰	صکوک اجاره خوارزم ۴۴۱-۶ ماهه ۲۰٪
۷۴,۱۸۷,۷۲۹,۰۸۸	۰	(۲,۰۴۹,۳۰۰)	۷۴,۱۸۹,۷۷۸,۳۸۸	۱۴,۹۳۷,۳۲۰,۶۸۱	۰	(۱,۷۰۷,۷۵۰)	۱۴,۹۳۹,۰۲۸,۴۳۱	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ بهمن ماه ۱۴۰۳

۱-۳-۲ سود سپرده بانکی و اوراق

از ابتدای سال مالی تا پایان بهمن ماه سال ۱۴۰۳			طی بهمن ماه ۱۴۰۳			نرخ		شرح
خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود	خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود	سود	تاریخ سر رسید	
						(درصد)		
ریال	ریال	ریال	ریال	ریال	ریال			
۳۲,۴۳۶,۳۷۷,۴۰۵	۰	۳۲,۴۳۶,۳۷۷,۴۰۵	۶,۵۵۰,۸۸۵,۰۰۱	۰	۶,۵۵۰,۸۸۵,۰۰۱	۱۸	۱۴۰۵/۰۹/۲۱	مراجعه ت.صنعتی مشفق ۱۴۰۵۰۹۲۱
۴۱,۷۵۳,۴۰۰,۹۸۳	۰	۴۱,۷۵۳,۴۰۰,۹۸۳	۸,۳۸۸,۱۴۳,۴۳۰	۰	۸,۳۸۸,۱۴۳,۴۳۰	۲۰	۱۴۰۴/۱۱/۱۸	صکوک اجاره خوارزم ۴۴۱۱-۶ماهه ۲۰٪
۱۲,۴۱۹,۹۲۷	۰	۱۲,۴۱۹,۹۲۷	۳,۳۲۱,۳۰۲	۰	۳,۳۲۱,۳۰۲	۵	-	بانک صادرات ۰۲۱۸۲۰۳۴۹۱۰۰۷
۱,۳۱۷,۵۰۳	۰	۱,۳۱۷,۵۰۳	۱۴۳,۱۲۸	۰	۱۴۳,۱۲۸	۵	-	بانک صادرات ۰۲۱۸۲۰۳۵۰۰۰۰۰
۲,۰۹۶,۵۰۲	۰	۲,۰۹۶,۵۰۲	۴۳۹,۲۷۹	۰	۴۳۹,۲۷۹	۵	-	بانک صادرات ۰۲۱۸۲۰۳۶۶۷۰۰۸
۲,۷۷۲,۱۰۷	۰	۲,۷۷۲,۱۰۷	۰	۰	۰	۵	-	بانک صادرات ۰۲۱۸۲۰۳۶۷۲۰۰۱
۱۵,۸۷۹,۲۱۹	۰	۱۵,۸۷۹,۲۱۹	۲,۷۴۰,۳۵۷	۰	۲,۷۴۰,۳۵۷	۵	-	بانک صادرات ۰۲۱۸۲۰۳۶۹۵۰۰۵
۲,۵۵۲,۹۱۷	۰	۲,۵۵۲,۹۱۷	۱۱۸,۳۲۸	۰	۱۱۸,۳۲۸	۵	-	بانک صادرات ۰۲۱۹۰۷۹۳۵۱۰۰۹
۷۴,۲۲۶,۸۱۶,۵۶۳	-	۷۴,۲۲۶,۸۱۶,۵۶۳	۱۴,۹۴۵,۷۹۰,۸۲۵	-	۱۴,۹۴۵,۷۹۰,۸۲۵			

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ بهمن ماه ۱۴۰۳

۲-۴- درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده:

نام سپرده بانکی		طی بهمن ماه ۱۴۰۳		از ابتدای سال مالی تا پایان بهمن ماه سال ۱۴۰۳	
نام سپرده	سود سپرده بانکی و گواهی سپرده	درصد سود به میانگین سپرده	سود سپرده بانکی و گواهی سپرده	درصد سود به میانگین سپرده	سود سپرده بانکی و گواهی سپرده
بانک صادرات ۰۲۱۸۲۰۳۴۹۱۰۰۷	۳,۳۲۱,۳۰۲	۴۹.۱۱	۱۲,۴۱۹,۹۲۷	۳۳.۵۳	
بانک صادرات ۰۲۱۸۲۰۳۵۰۰۰۰۰	۱۴۳,۱۲۸	۲.۱۲	۱,۳۱۷,۵۰۳	۳.۵۶	
بانک صادرات ۰۲۱۸۲۰۳۶۶۷۰۰۸	۴۳۹,۲۷۹	۶.۵۰	۲,۰۹۶,۵۰۲	۵.۶۶	
بانک صادرات ۰۲۱۸۲۰۳۶۷۲۰۰۱	۰	۰.۰۰	۲,۷۷۲,۱۰۷	۷.۴۸	
بانک صادرات ۰۲۱۸۲۰۳۶۹۵۰۰۵	۲,۷۴۰,۳۵۷	۴۰.۵۲	۱۵,۸۷۹,۲۱۹	۴۲.۸۷	
بانک صادرات ۰۲۱۹۰۷۹۳۵۱۰۰۹	۱۱۸,۳۲۸	۱.۷۵	۲,۵۵۲,۹۱۷	۶.۸۹	
جمع	۶,۷۶۲,۳۹۴	۱۰۰	۳۷,۰۳۸,۱۷۵	۱۰۰	

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ بهمن ماه ۱۴۰۳

۲-۵- سایر درآمدها:

از ابتدای سال مالی تا پایان بهمن ماه سال ۱۴۰۳	طی بهمن ماه ۱۴۰۳	
مبلغ	مبلغ	سایر درآمدها
ریال	ریال	
۱۷۴,۱۸۱,۶۶۰,۲۹۳	۳۰,۲۰۱,۴۰۸,۷۵۶	کارمزد بازارگردانی
۸۸۴,۴۳۴,۵۴۶	.	سایر درآمدها
۱۷۵,۰۶۶,۰۹۴,۸۳۹	۳۰,۲۰۱,۴۰۸,۷۵۶	جمع